

# 台指選擇權OI匯報

日期：2022/11/30 結算日：2022/12/7					日期：2022/11/30 結算日：2022/12/21				
202212W1					202212 月台指選擇權 OI 序列				
OI 增減	Call	履約價	Put	OI 增減	OI 增減	Call	履約價	Put	OI 增減
23	45	14,200	3,379	1,830	-12	886	13,600	3,421	-98
2	39	14,300	4,778	3,231 ※	0	521	13,700	5,017	-123
-5	87	14,350	1,395	718	-1	950	13,800	3,629	802
90	193	14,400	2,747	1,772	-15	1,592	13,900	3,052	474
44	107	14,450	1,840	1,125	-55	3,370	14,000	7,843	652
45	179	14,500	2,698	1,939	-33	1,790	14,100	3,210	169
119	276	14,550	2,499	2,193	5	2,202	14,200	6,078	-38
30	364	14,600	2,884	2,557	-7	1,853	14,300	3,356	323
85	810	14,650	1,325	986	-74	1,548	14,400	2,490	-53
159	760	14,700	1,278	1,085	-7	3,391	14,500	2,548	14
430	1,008	14,750	646	548	-106	2,980	14,600	2,423	155
1,719	2,413	14,800	1,009	916	194	3,037	14,700	1,162	167
610	1,289	14,850	481	380	-213	3,398	14,800	1,395	358
716	1,765	14,900	278	236	-214	3,123	14,900	541	44
509	1,790	14,950	171	144	-118	5,889	15,000	537	48
1,338	3,059	15,000	78	37	332	3,927	15,100	177	-1
947	1,797	15,050	40	40	-347	5,282	15,200	168	-9
1,216	2,612	15,100	19	18	-217	5,525	15,300	85	23
879	1,402	15,150	4	4	346	4,446	15,400	525	5
1,512	2,775	15,200	22	22	-11	4,001	15,500	28	0
※ 1,790	2,902	15,300	7	3	※ 993	4,221	15,600	56	0
1,368	1,727	15,400	0	0	41	2,580	15,700	33	0
829	1,487	15,500	0	0	239	3,569	15,800	447	40
715	1,253	15,600	0	0	-39	1,577	15,900	65	0
638	899	15,700	0	0	204	3,970	16,000	24	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計	增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
16,436	32,104	1.2540	40,260	24,711	1,125	115,285	0.9949	114,699	4,670
昨日 P/C	1.0879	今日增減變化	0.1661		昨日 P/C	0.9638	今日增減變化	0.0311	

更新日期：2022年11月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指期貨、選擇權籌碼匯報

期貨三大法人未平倉金額匯報					2022年11月30日			
單位：千元	臺股期貨				電子期貨			
	買方金額	賣方金額	淨部位	淨部位增減	買方金額	賣方金額	淨部位	淨部位增減
外資	132,461,666	94,535,192	37,926,474	5,110,808	3,850,954	1,347,697	2,503,257	-162,169
投信	43,467,553	54,409,192	-10,941,639	704,265	441,913	0	441,913	3,574
自營商	25,424,553	22,296,180	3,128,373	-959,154	1,284,275	1,671,397	-387,122	-234,552
	金融期貨				非金電期貨			
	買方金額	賣方金額	淨部位	淨部位增減	買方金額	賣方金額	淨部位	淨部位增減
外資	686,372	1,277,804	-591,432	142,585	79,167	89,243	-10,076	33,969
投信	107,392	0	107,392	1,436	0	0	0	0
自營商	415,546	175,852	239,694	30,835	191,130	198,370	-7,240	-38,497

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報					2022年11月30日			
	買權 CALL				賣權 PUT			
	買方口數	賣方口數	淨部位	淨部位增減	買方口數	賣方口數	淨部位	淨部位增減
外資	44,816	12,793	32,023	-1,137	19,635	12,928	6,707	-1,582
投信	200	100	100	0	200	121	79	0
自營商	54,873	72,241	-17,368	8,354	62,502	45,910	16,592	5,856
特定法人(週)	410	0	410	---	0	850	-850	---
特定法人(近月)	28,909	3,522	25,387	528	3,961	10,326	-6,365	0
特定法人(全月)	34,392	3,798	30,594	-1,015	4,202	14,085	-9,883	-2,685
十大交易人(週)	14,982	15,593	-611	---	20,445	17,981	2,464	---
十大交易人(近月)	67,186	58,897	8,289	921	50,336	54,464	-4,128	1,308
十大交易人(全月)	90,270	83,408	6,862	15,667	73,551	78,054	-4,503	-6,332
全市場未沖銷(近月)			115,285	1,125			114,699	4,670
全市場未沖銷(全月)			172,111	-99,359			179,047	-98,946

更新日期：2022年11月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指選擇權匯報

## 2022年12W1週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15200	買權OI最大量	15000
	賣權成交最大量	14300	賣權OI最大量	14300
	整體隱含波動率	15.16%	較前一交易日	+5.33%
	買權隱含波動率	15.01%	較前一交易日	+7.10%
	賣權隱含波動率	15.30%	較前一交易日	+3.92%
電子選擇權	買權成交最大量	700	買權OI最大量	640
	賣權成交最大量	690	賣權OI最大量	650
金融選擇權	買權成交最大量	1600	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1520

更新日期：2022年11月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

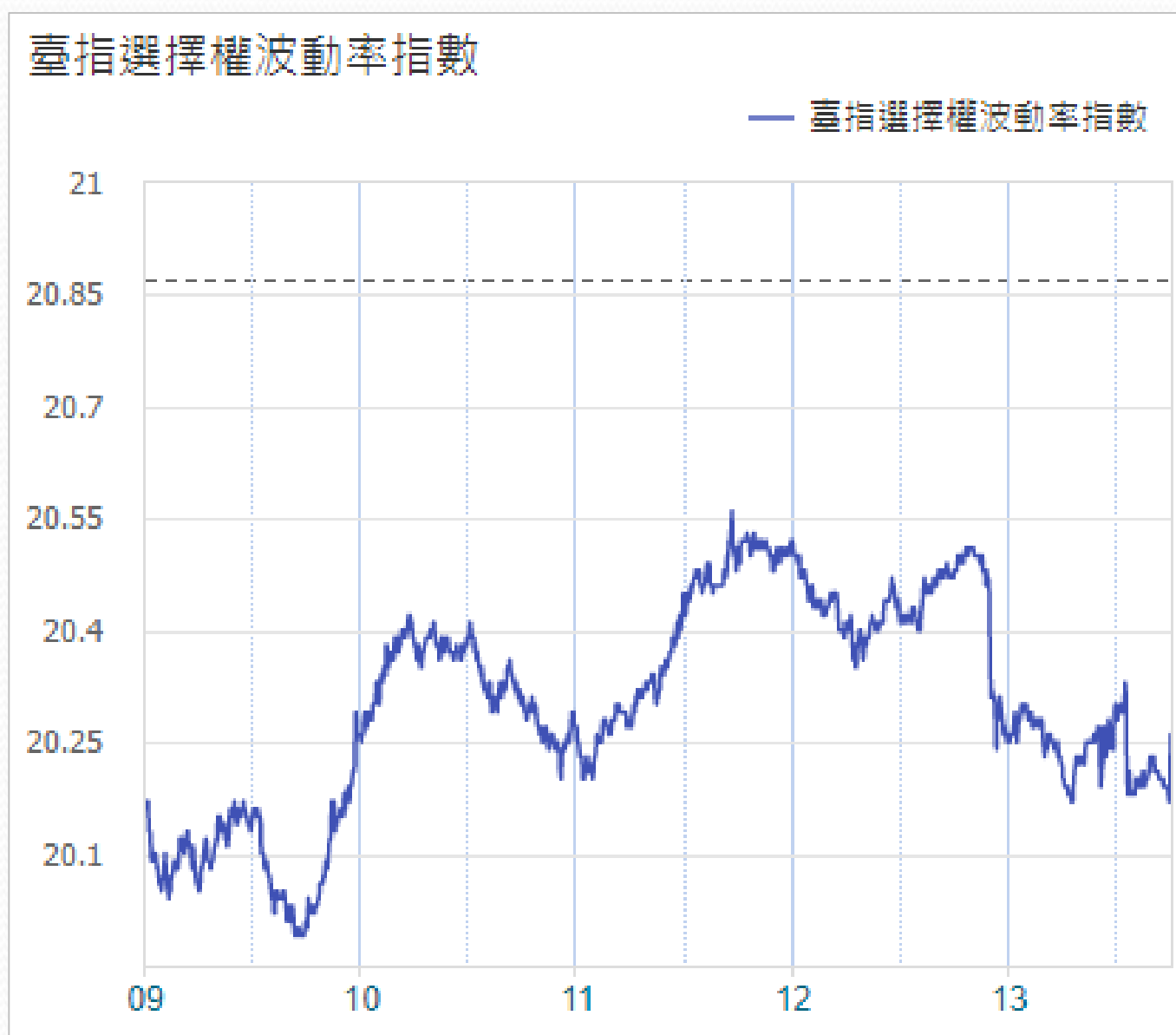
# 台指選擇權匯報

## 2022年12月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15000	買權OI最大量	15000
	賣權成交最大量	14000	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	19.63%	較前一交易日	+0.61%
	買權隱含波動率	15.16%	較前一交易日	-1.41%
	賣權隱含波動率	24.25%	較前一交易日	+0.79%
	成交量P/C_Ratio值	0.882	較前一交易日	-0.02
	未平倉P/C_Ratio值	0.995	較前一交易日	+0.03
電子選擇權	買權成交最大量	700	買權OI最大量	640
	賣權成交最大量	690	賣權OI最大量	650
金融選擇權	買權成交最大量	1600	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1520

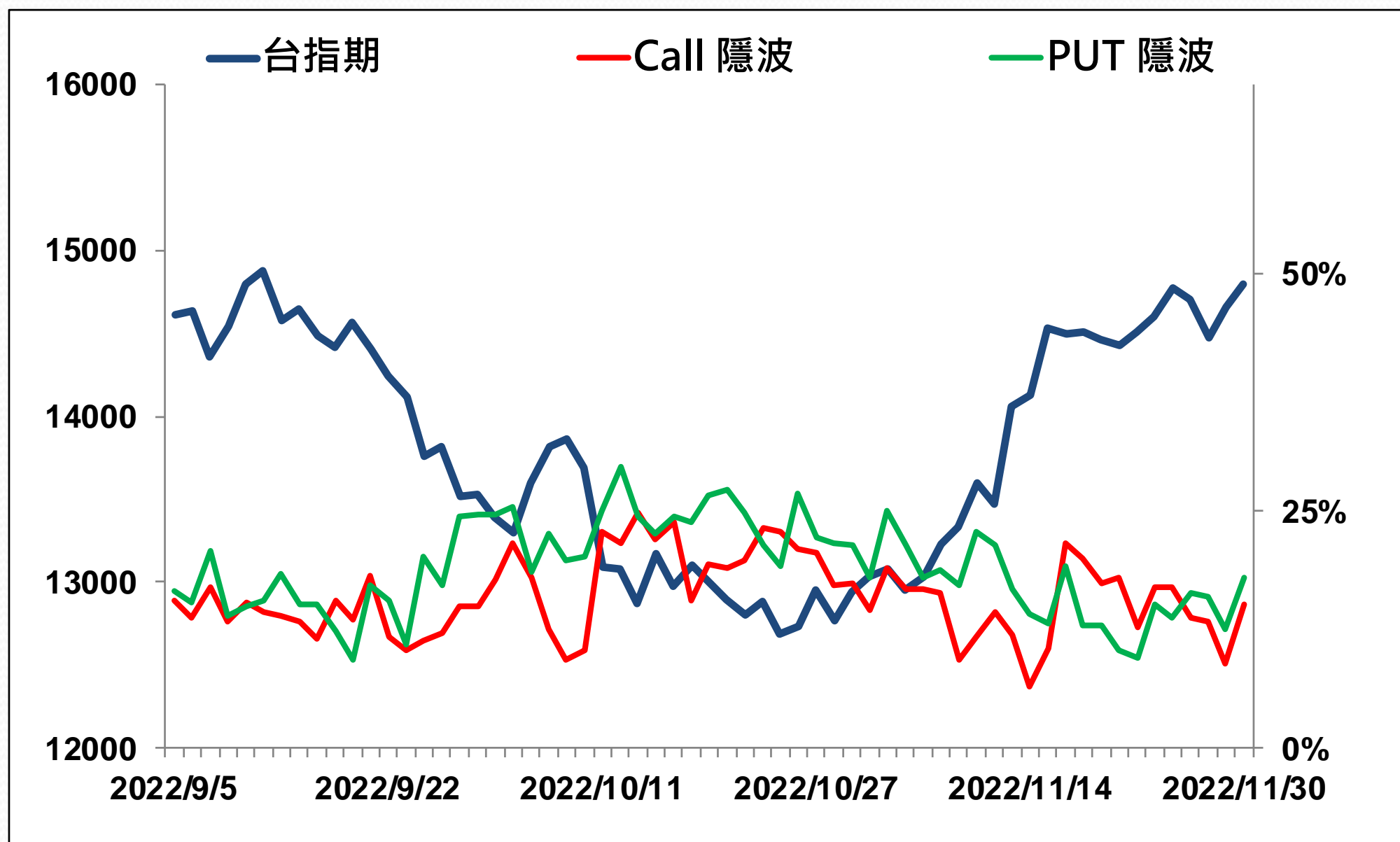
更新日期：2022年11月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權當日波動率指數



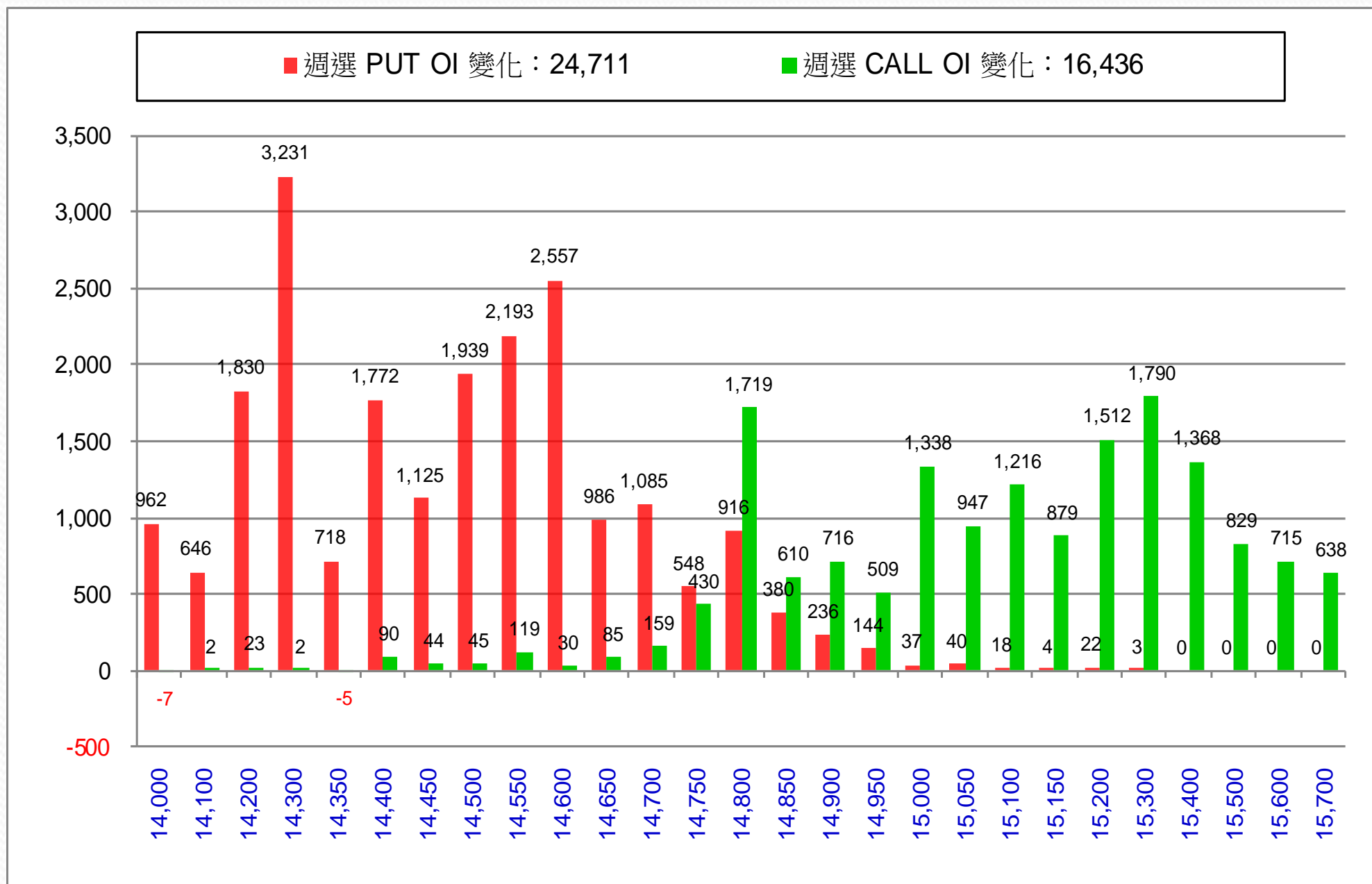
更新日期：2022年11月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2022年11月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI每日變化量

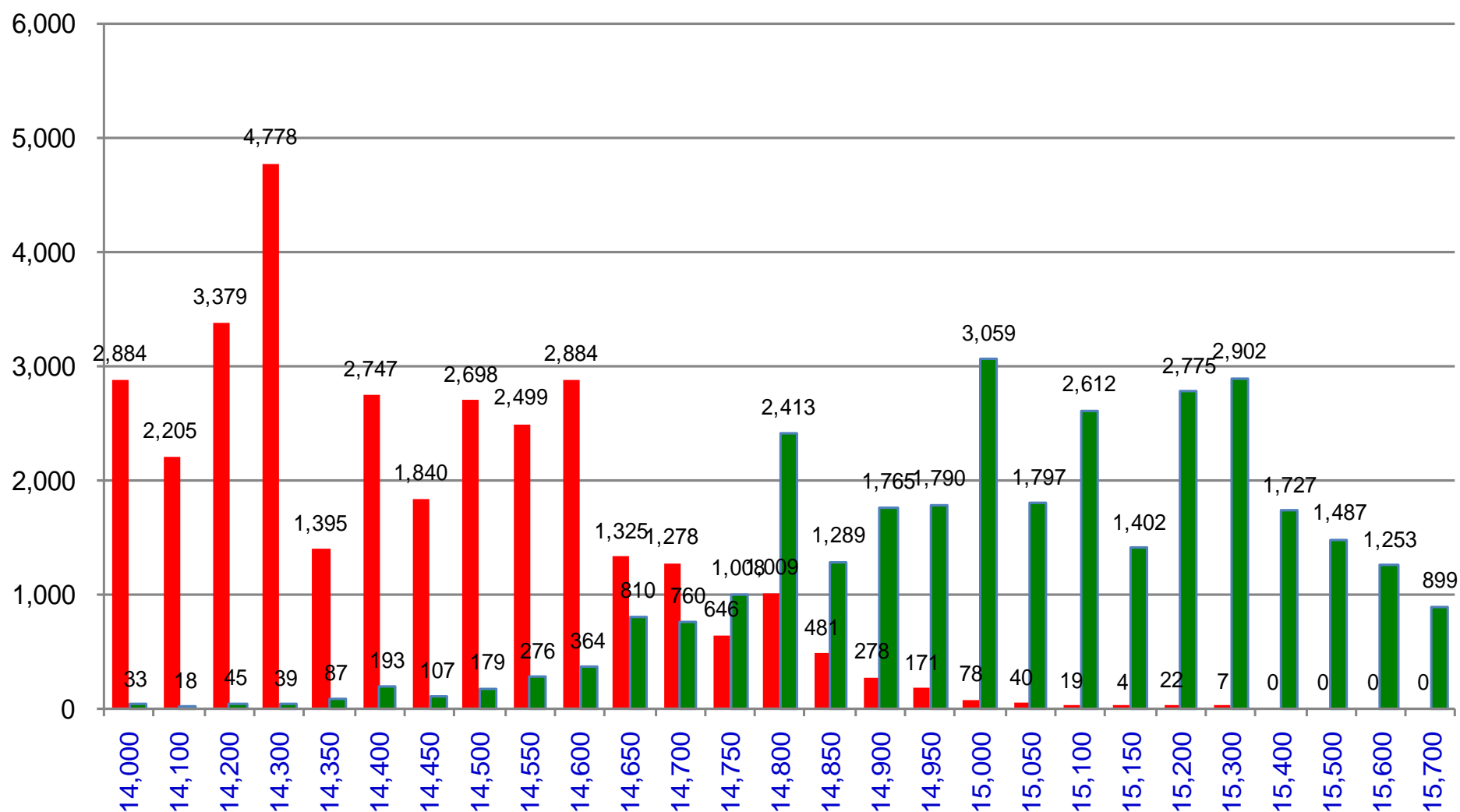


更新日期：2022年11月30日    資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：40,260

週選 CALL OI 總額：32,104



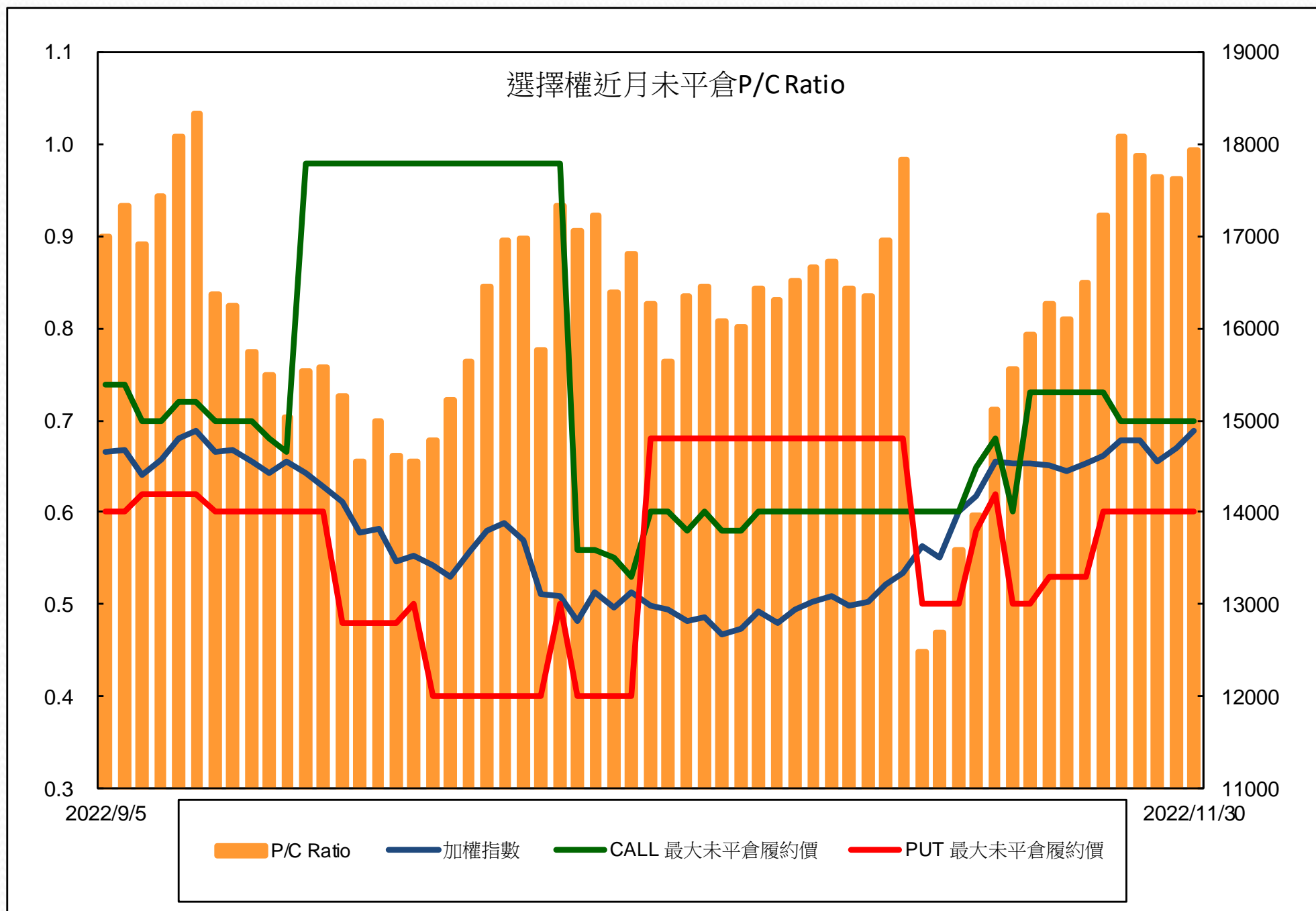
更新日期：2022年11月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 自營商選擇權OI部位統計

選擇權	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	11月29日	68,201	93,923	-25,722
	11月30日	54,873	72,241	-17,368
Put	11月29日	76,402	65,666	10,736
	11月30日	62,502	45,910	16,592

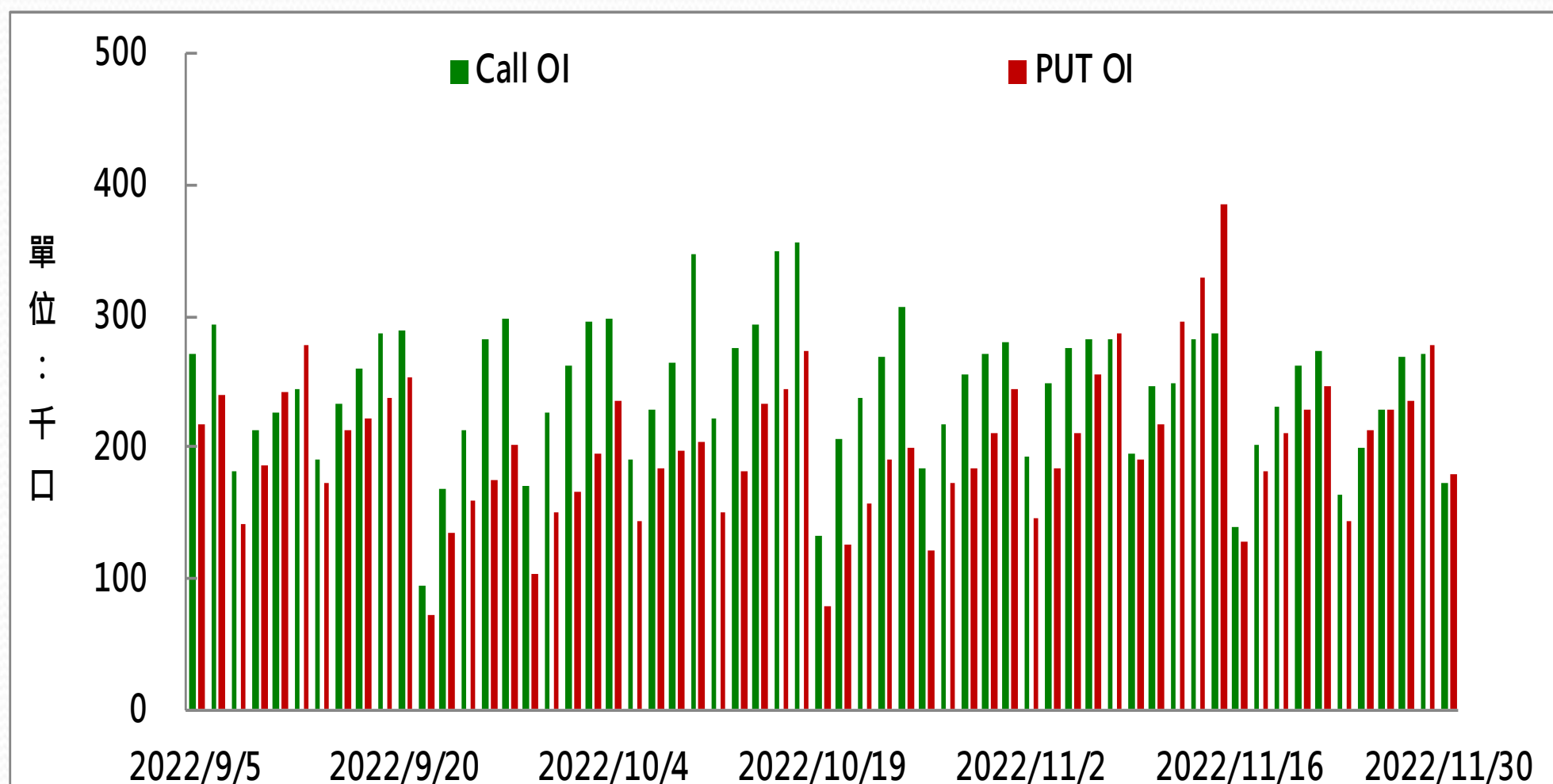
更新日期：2022年11月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年11月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整

# 選擇權全月Put Call OI



更新日期：2022年11月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 免責聲明及警語

- 一、本報告中的訊息包括來自各項已公開或據信為可靠之資訊來源，為製作報告當時所知之資訊及基於特定時間或期間所作之意見，惟凱基期貨股份有限公司（以下稱本公司）對本報告內容的準確性、完整性和及時性不作任何聲明或保證，本報告所載之資訊或意見日後如有任何變動，本公司將不作通知。
- 二、本報告內容僅供參考，不具有或隱含任何法律效果，本公司就其內容不負任何法律責任。本報告內容不代表未來獲利之預期或保證，交易人應審慎評估，慎重考量自身財務能力及承受風險能力，並特別留意控管風險，如有需要，應諮詢相關財務顧問或專業人士。
- 三、本報告內容不構成亦不得視為對任何投資標的或任何交易之招攬、要約、宣傳、廣告、遊說、引誘或推薦。在任何情況下，本公司不對任何人閱讀本報告或基於本報告觀點所進行的交易所引致的任何損益承擔任何責任。
- 四、本報告內容所涉相關圖表及數據可能採用特定軟體及程式、模型運算，以歷史數據進行繪製及統計，其結果並不代表具有預測未來之能力。
- 五、本報告內容所用技術分析指標可能隨參數設定之不同，而有不同的結果。技術分析指標係將過去歷史資料經由統計分析技術所得之指標數值，僅供參考性質，通常作為事後驗證之用途，且係依據過去歷史資料所得，不具領先意涵，亦不代表具有預測未來之能力。
- 六、本報告內容之著作權屬於本公司所擁有，非經本公司事先書面同意，禁止任何未經本公司授權擅自加以摘錄、引用、轉貼、下載、複製、編輯、翻譯或傳輸行為，任何侵犯本公司著作權之行為，本公司將予究責。
- 七、本報告僅限由本公司傳送予與本公司簽訂顧問契約之客戶閱讀，如有任何人未經本公司事先書面同意而將本報告傳送予他人，本公司將予究責。

許可證照字號：110年金管期總字第005號 KGI凱基期貨地址：台北市重慶南路一段2號6樓部份、12樓及13樓

<http://www.kgifutures.com.tw> 電話(02)2361-9889

更新日期：2022年11月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考